

## 工银瑞信信息产业混合型证券投资基金

## [2016] 第一季度报告

基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一六年四月二十二日

\$ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等信息，保证复核后的内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中财务数据未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

\$ 2 基金产品概况

基金简称	工银瑞信信息产业混合型证券投资基金
交易代码	000203
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月11日
报告期末基金份额总额	695,309,043.97份

基金份额的类别名称:信息产业股票型基金、信息产业债券型基金、信息产业混合型基金。

分属不同的类别,分别根据不同的投资比例,确定基金的股票、债券、货币市场工具及现金的配置比例。

投资目标:通过合理的资产配置,在控制投资风险的同时,力争创造超越业绩比较基准的投资回报。

投资策略:本基金将主要投资于具有良好成长性的信息产业类企业,并辅以适当的资产配置,在控制投资风险的同时,力争创造超越业绩比较基准的投资回报。

业绩比较基准:95%×中国TMT行业股票指数收益率+2%×恒生指数收益率。

风险收益特征:本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于风险水平适中的基金。本基金主要投资于信息产业类企业,并辅以适当的资产配置,在控制投资风险的同时,力争创造超越业绩比较基准的投资回报。

基金经理:王延杰 工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

\$ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)

1.本期已实现收益 -194,296,760.73

2.本期利润 -76,430,122.49

3.加权平均基金份额本期利润 -0.1012

4.期末基金资产净值 1,327,765,334.92

5.期末基金份额净值 1.962

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益"指本基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额;"本期利润"为本基金实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.所列数据截至到2016年3月31日。

4.基金净值表现

5.期末基金资产净值

6.期末基金份额净值

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期内按行业分类的境内股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 69,077,749.52 4.36%

B 制造业 369,247,970.00 26.01%

C 制造业 706,219,494.62 52.99%

D 地力、热气、燃气及生产供应业 106,436.66 0.01%

E 建筑业 227,007,062.00 16.09%

F 邮电及计算机 46,979,453.94 3.01%

G 交通运输、仓储和邮政业 19,947,265.41 1.49%

H 日用零售、饮食业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 197,326,065.01 14.76%

J 金融业 447,023.00 0.03%

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究、技术服务和地质勘查业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 31,520.00 0.00%

O 国防、航天、核工业 - -

P 教育 - -

Q 卫生、社会保障和社会工作 - -

R 文化、体育和娱乐业 - -

S 其他 - -

合计 1,327,765,334.92 94.45

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.2 报告期内按行业分类的境外股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 小基金资产净值比例(%)

1 中信银行 13,344,850 147,193,507.99 11.00%

2 中国平安 7,537,904 126,109,133.92 9.45%

3 中国国航 6,064,942 116,543,474.66 8.71%

4 中国太保 3,426,791 96,538,790.28 7.22%

5 东方财富 2,276,427 79,074,048.00 5.96%

6 中国银行 2,050,280 72,876,119 5.44%

7 ST信凯 6,520,389 70,097,341.92 5.31%

8 东方明珠 8,476,597 64,162,979.29 4.80%

9 中国国旅 3,696,873 61,886,807.67 4.63%

10 中国铝业 2,333,648 61,004,046.43 4.07%

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证及投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票期权及权证投资明细

本基金本报告期末未持有股票期权。

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货及国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货及国债期货。

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资明细

本基金本报告期末未持有商品期货。

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金白银投资明细

本基金本报告期末未持有黄金白银。

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名外汇投资明细

本基金本报告期末未持有外汇。

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他投资明细

本基金本报告期末未持有其他投资。

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证及投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货及国债期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货及国债期货。

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资明细

本基金本报告期末未持有商品期货。

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金白银投资明细

本基金本报告期末未持有黄金白银。

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名外汇投资明细

本基金本报告期末未持有外汇。

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他投资明细

本基金本报告期末未持有其他投资。

5.25 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票期权及权证投资明细

本基金本报告期末未持有股票期权。

5.26 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资明细

本基金本报告期末未持有商品期货。

5.27 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金白银投资明细

本基金本报告期末未持有黄金白银。

5.28 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名外汇投资明细

本基金本报告期末未持有外汇。

5.29 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他投资明细

本基金本报告期末未持有其他投资。

5.30 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票期权及权证投资明细

本基金本报告期末未持有股票期权。

5.31 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资明细

本基金本报告期末未持有商品期货。

5.32 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金白银投资明细

本基金本报告期末未持有黄金白银。

5.33 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名外汇投资明细

本基金本报告期末未持有外汇。

5.34 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他投资明细

本基金本报告期末未持有其他投资。

5.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票期权及权证投资明细

本基金本报告期末未持有股票期权。

5.36 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资明细

本基金本报告期末未持有商品期货。

5.37 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金白银投资明细

本基金本报告期末未持有黄金白银。

5.38 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名外汇投资明细

本基金本报告期末未持有外汇。

5.39 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他投资明细

本基金本报告期末未持有其他投资。

5.40 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票期权及权证投资明细

本基金本报告期末未持有股票期权。

5.41 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资明细

本基金本报告期末未持有商品期货。

5.42 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名黄金白银投资明细

本基金本报告期末未持有黄金白银。

5.43 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名外汇投资明细

本基金本报告期末未持有外汇。

5.44 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名